

## ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 31/01/2022

O Relatório de Análise de Investimentos (RAI) apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e retorno. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações apresentadas foram extraídas dos relatórios de risco de mercado já produzidos pela ADITUS. A seguir, uma fotografia da alocação segregada por mandatos ou segmentos, de acordo com as especificações da Política de Investimentos.

VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
<b>Renda Fixa</b>	<b>1.128.476.335,43</b>	<b>65,75%</b>				<b>-0,43%</b>	<b>1,87%</b>	<b>-0,01%</b>	<b>-0,43%</b>	<b>0,37%</b>	<b>5,92%</b>	<b>13,91%</b>	
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>693.462.736,24</b>	<b>40,41%</b>											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	693.462.736,24	40,41%		100%	3,38%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>435.013.599,19</b>	<b>25,35%</b>											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	275.113.109,00	16,03%	ALFA	40,56%	0,03%	0,80%	2,37%	3,82%	0,80%	5,40%	7,98%	14,19%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	8.627.058,28	0,50%	BRADESCO	42,45%	0,01%	0,72%	2,04%	3,39%	0,72%	4,88%	7,45%	13,60%	
URCA FI MULT CRED PRIV	151.273.431,91	8,81%	SANTANDER	39,95%	0,04%	0,94%	2,49%	3,48%	0,94%	4,90%	7,56%	14,04%	
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	
<b>Renda Variável</b>	<b>402.620.187,91</b>	<b>23,46%</b>				<b>6,19%</b>	<b>7,35%</b>	<b>-9,88%</b>	<b>6,19%</b>	<b>-2,73%</b>	<b>-4,35%</b>	<b>19,29%</b>	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					7,04%	8,90%	-8,23%	7,04%	-0,15%	3,49%	25,59%	
<b>RV ATIVO</b>	<b>195.205.976,35</b>	<b>11,37%</b>											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	124.904.720,54	7,28%	SHARP	30,04%	7,12%	7,56%	8,15%	-8,06%	7,56%	-2,06%	3,81%	27,87%	
FIA SAO CONRADO	9.153.985,32	0,53%	EQUITAS	30,04%	10,79%	8,69%	1,84%	-23,51%	8,69%	-18,02%	-27,70%	-9,64%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	47.265.089,24	2,75%	CONSTANCIA	30,04%	5,85%	3,70%	6,68%	-7,88%	3,70%	3,35%	-9,01%	-	
FIA PIPA	7.495.577,52	0,44%	XP	30,04%	5,84%	5,86%	8,42%	-12,77%	5,86%	-4,00%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	6.386.603,72	0,37%	CONSTELLATION	30,04%	7,94%	0,54%	-7,78%	-26,66%	0,54%	-25,93%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA					6,98%	8,35%	-7,93%	6,98%	-2,54%	-1,42%	15,14%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RV</b>	<b>109.584.749,17</b>	<b>6,39%</b>											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV	109.584.749,17	6,39%		100%	7,13%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					6,87%	8,36%	-9,14%	6,87%	-2,11%	-0,51%	18,37%	
<b>RV VALOR</b>	<b>52.917.425,14</b>	<b>3,08%</b>											
VINCI JOATINGA FIA	44.269.851,18	2,58%	VINCI	30,04%	7,70%	7,36%	11,59%	-6,89%	7,36%	-2,58%	-4,04%	-	
FIA ITACOATIARA	8.647.573,97	0,50%	INDIE CAPITAL	30,04%	9,94%	4,03%	1,66%	-24,18%	4,03%	-19,29%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA					6,98%	8,35%	-7,93%	6,98%	-2,54%	-1,42%	15,14%	
<b>RV SMALL CAP</b>	<b>44.912.037,25</b>	<b>2,62%</b>											
GRUMARI FIA	44.912.037,25	2,62%	AZ QUEST	30,04%	8,62%	2,66%	0,49%	-14,13%	2,66%	-4,98%	-13,44%	26,66%	
Benchmark:	SMLL					3,42%	4,89%	-17,43%	3,42%	-10,25%	-14,29%	24,49%	
<b>Estruturado</b>	<b>60.837.339,44</b>	<b>3,54%</b>											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					1,47%	4,76%	10,80%	1,47%	21,66%	41,07%	61,92%	
<b>MM MACRO</b>	<b>40.211.362,26</b>	<b>2,34%</b>											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	11.668.247,09	0,68%	QUANTITAS	4,92%		3,90%	5,28%	4,46%	3,90%	6,85%	16,37%	24,78%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	4.125.026,54	0,24%	OCCAM	0,23%	1,19%	0,70%	-0,17%	2,16%	0,70%	4,22%	11,77%	26,34%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	16.328.424,28	0,95%	OCCAM	0,74%	1,19%	0,70%	-0,18%	2,16%	0,70%	4,19%	11,72%	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	3.869.121,94	0,23%	PACIFICO	1,70%	1,86%	0,15%	1,92%	-0,65%	0,15%	-0,32%	0,72%	8,71%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	4.220.542,41	0,25%	ZEITGEIST	0,21%	6,80%	0,36%	-0,05%	6,07%	0,36%	11,49%	15,76%	27,79%	
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	
<b>MM LONG-SHORT</b>	<b>20.625.977,18</b>	<b>1,20%</b>											
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	20.625.977,18	1,20%	KONDOR	4,60%	1,62%	1,04%	4,00%	4,09%	1,04%	8,24%	10,81%	-	
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	
<b>Exterior</b>	<b>36.495.410,47</b>	<b>2,13%</b>											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					-9,13%	-8,52%	4,26%	-9,13%	12,44%	63,87%	121,23%	
<b>RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>36.495.410,47</b>	<b>2,13%</b>											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	36.495.410,47	2,13%	BLACKROCK	0,00%	6,69%	-11,30%	-7,99%	4,01%	-11,30%	18,36%	76,41%	148,53%	
Benchmark:	MSCIWBRLL					-9,13%	-8,52%	4,26%	-9,13%	12,44%	63,87%	121,23%	
<b>Operações com Participantes **</b>	<b>35.363.393,70</b>	<b>2,06%</b>											
Benchmark:	INPC + 8,68% a.a.					1,37%	4,44%	10,13%	1,37%	20,20%	37,72%	56,17%	
<b>Imobiliário **</b>	<b>52.443.327,46</b>	<b>3,06%</b>											
Benchmark:	INPC					0,67%	2,26%	5,61%	0,67%	10,60%	16,72%	21,74%	
<b>Total</b>	<b>1.716.235.994,41</b>	<b>100%</b>				<b>2,62%</b>	<b>0,92%</b>	<b>2,87%</b>	<b>-2,06%</b>	<b>0,92%</b>	<b>0,83%</b>	<b>5,62%</b>	<b>16,21%</b>
Benchmark:	INPC + 4,8% a.a.					1,06%	3,48%	8,13%	1,06%	15,91%	28,12%	40,08%	

- Rentabilidades de Carteiras, Segmentos e Planos foram informados pela (o) ELETROS

\*\* Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 31/12/2021

\* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.



## Análises de Contrapartes

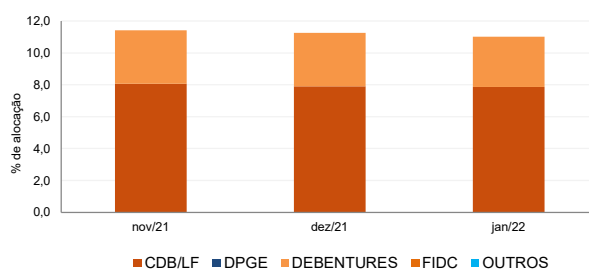
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	86.731,30	5,32	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	43.517,90	2,67	Faixa 2
VALE SA	43.346,58	2,66	Faixa 1
BCO SAFRA SA	22.482,59	1,38	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	17.197,25	1,05	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	16.278,75	1,00	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	13.864,01	0,85	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	13.784,86	0,84	Faixa 2
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	12.854,39	0,79	Sem Faixa
EQUATORIAL ENERGIA SA	12.731,15	0,78	Faixa 1

\* em mil R\$

### Alocação Por Tipo de Crédito



## Mudanças de Faixa de Risco de Crédito no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são checadas primeiro verificando a faixa correspondente da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Faixa Anterior	Faixa Atual	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 31/01/2022

## Aquisições de Ativos no Mês

As tabelas a seguir apresentam os títulos adquiridos no último mês. Esses dados são extraídos dos arquivos XMLs da carteira e dos fundos com alocação direta.

É apresentada a faixa de risco de crédito da emissão e, em caso de inexistência, apresenta-se a faixa do emissor.

Títulos Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
LF CDI	01-fev-24	2.319.922	0,14%	CDI	BCO ITAU SA	26-jan-22	0,65%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI	01-abr-24	2.322.526	0,14%	CDI	BCO ITAU SA	21-jan-22	0,66%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	27.017.834	1,66%	IPCA		18-jan-22	5,46%	5,47%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	17.561.592	1,08%	IPCA		06-jan-22	5,35%	5,39%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	3.782.497	0,23%	IPCA		06-jan-22	5,35%	5,39%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	3.310.852	0,20%	IPCA		05-jan-22	5,53%	5,56%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	2.814.224	0,17%	IPCA		06-jan-22	5,56%	5,61%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	317.290	0,02%	IPCA		05-jan-22	5,53%	5,56%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F

